

## 【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長殿

【提出日】 平成25年9月11日提出

【発行者名】 大和証券投資信託委託株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 白川 真

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

【事務連絡者氏名】 山部 努  
連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

【電話番号】 03-5555-3111

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 DCダイワ・ターゲットイヤー2020

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】 継続申込期間（平成25年3月12日から平成26年3月11日まで）  
10兆円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当ありません。

．【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成25年3月11日付で提出した「DCダイワ・ターゲットイヤー2020」有価証券届出書（以下「原有有価証券届出書」）の記載事項を、半期報告書の提出に伴い新たな内容に改めるため、本訂正届出書を提出致します。

．【訂正の内容】

（ 下線部\_\_\_\_は訂正部分を示します。）

## 第二部 【ファンド情報】

### 第1 【ファンドの状況】

#### 1 【ファンドの性格】

##### (1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

< 訂正前 >

< 略 >

< ファンドの特色 >

1 < 略 >

< 略 >

< 2012年12月時点の基本配分比率 >

	わが国の 株式	海外の 株式	わが国の リート	海外の リート	わが国の 債券	海外の 債券
DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	18%	12%	5%	5%	37%	23%

< 略 >

ファンドの基本配分比率のイメージ

< 略 >

(注1) 2012年12月現在で計画している基本配分比率であり、将来の基本配分比率は市況動向等により変更となる場合があります。2011年以前は過去の基本配分比率を示しています。

< 略 >

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

< ファンドの特色 >

1 < 略 >

< 略 >

< 2013年7月時点の基本配分比率 >

	わが国の 株式	海外の 株式	わが国の リート	海外の リート	わが国の 債券	海外の 債券
DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	17%	12%	5%	5%	38%	23%

< 略 >

ファンドの基本配分比率のイメージ

< 略 >

(注1) 2013年7月現在で計画している基本配分比率であり、将来の基本配分比率は市況動向等により変更となる場合があります。2012年以前は過去の基本配分比率を示しています。

< 略 >

< 略 >

### (3) 【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

< 略 >

< 委託会社の概況(平成24年12月末日現在) >

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

< 委託会社の概況(平成25年7月末日現在) >

< 略 >

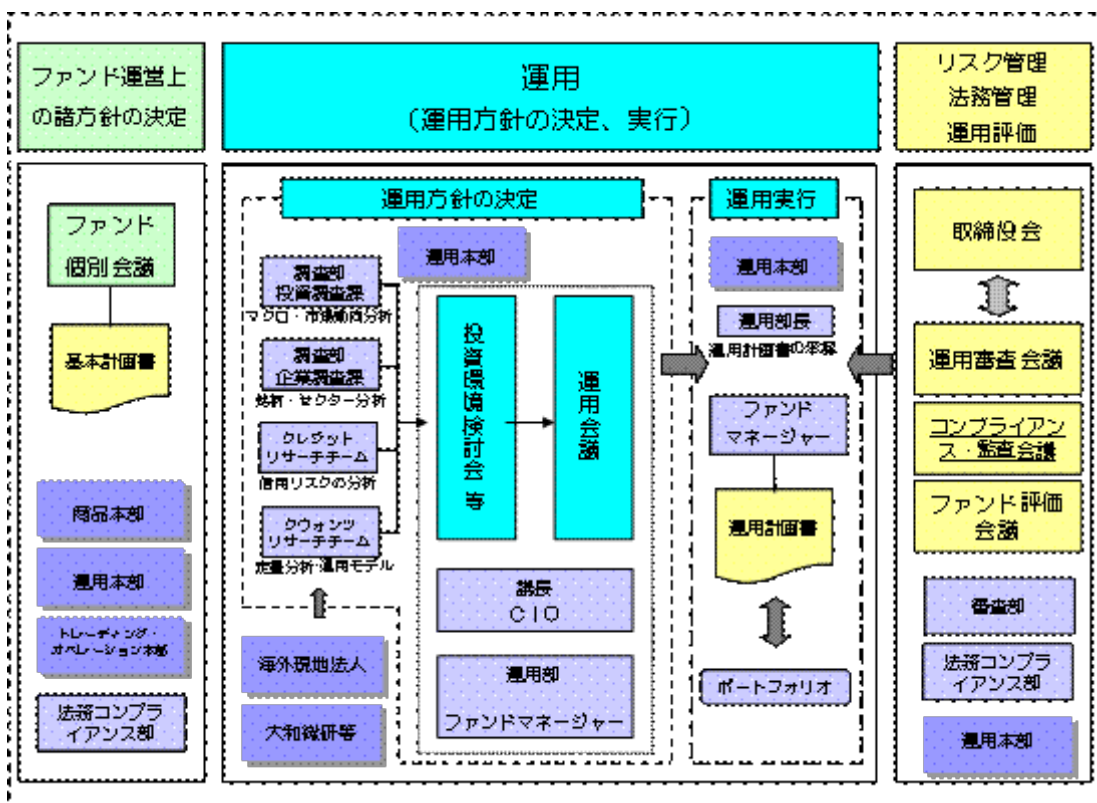
## 2 【投資方針】

### (3) 【運用体制】

< 訂正前 >

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



&lt; 略 &gt;

## 職務権限

&lt; 略 &gt;

ロ．インベストメント・オフィサー（1～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ニ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

ファンド評価会議、運用審査会議およびコンプライアンス・監査会議

ファンド評価会議は、運用実績・運用リスクの状況について、分析・検討を行ない、運用部にフィードバックします。また、運用審査会議は、経営会議の分科会として、ファンドの運用実績を把握し評価するとともに、取締役会から権限を委任され、ファンドの運用リスク管理の状況についての報告を受けて、必要事項を審議・決定します。

さらに、運用が適切に行なわれたかについて、経営会議の分科会であるコンプライアンス・監査会議において法令等の遵守状況に関する報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

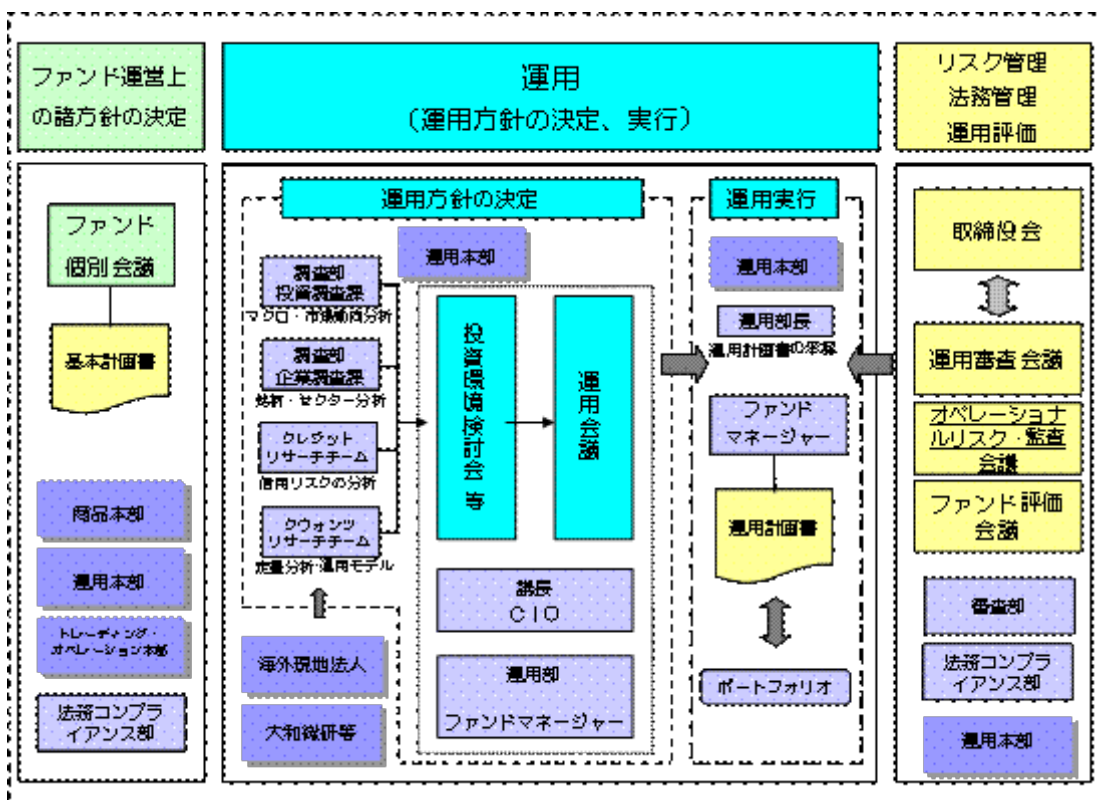
&lt; 略 &gt;

上記の運用体制は平成24年12月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

&lt; 訂正後 &gt;

## 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



< 略 >

#### 職務権限

< 略 >

#### ロ . Deputy-CIO（1～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

#### ハ . インベストメント・オフィサー（1～5名程度）

CIOおよびDeputy-CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

#### ニ . 運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

#### ホ . ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

#### ファンド評価会議、運用審査会議およびオペレーショナルリスク・監査会議

ファンド評価会議は、運用実績・運用リスクの状況について、分析・検討を行ない、運用部にフィードバックします。また、運用審査会議は、経営会議の分科会として、ファンドの運用実績を把握し評価するとともに、取締役会から権限を委任され、ファンドの運用リスク管理の状況についての報告を受けて、必要事項を審議・決定します。

さらに、運用が適切に行なわれたかについて、経営会議の分科会であるオペレーショナルリスク・監査会議において法令等の遵守状況に関する報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

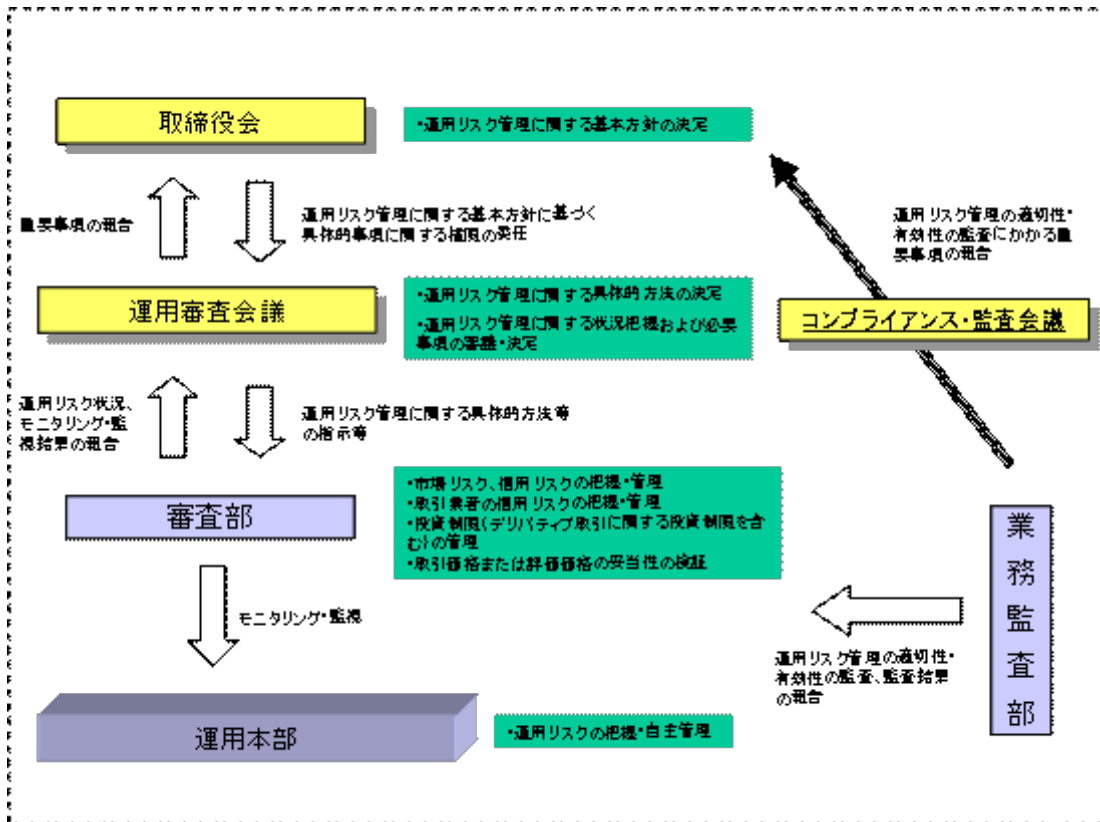
< 略 >

上記の運用体制は平成25年7月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

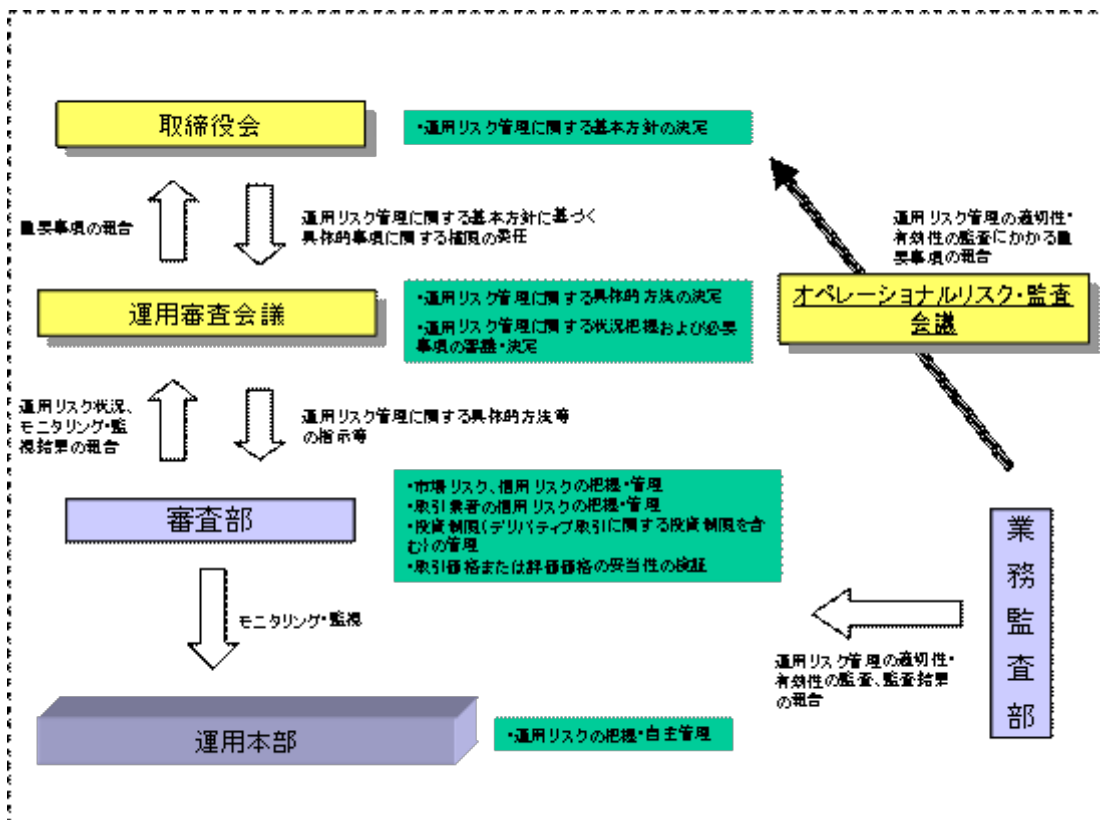
### 3 【投資リスク】

#### (4) リスク管理体制

< 訂正前 >



&lt; 訂正後 &gt;



## 4 【手数料等及び税金】

## (5) 【課税上の取扱い】

&lt; 訂正前 &gt;

&lt; 略 &gt;

( ) 上記は、平成25年1月1日現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

&lt; 略 &gt;

&lt; 訂正後 &gt;

&lt; 略 &gt;

( ) 上記は、平成25年7月末現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

&lt; 略 &gt;



## 5 【運用状況】

原有価証券届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

## (1) 【投資状況】（平成25年7月31日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	65,527,208	99.80
内 日本	65,527,208	99.80
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	129,714	0.20
純資産総額	65,656,922	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

## (2) 【投資資産】（平成25年7月31日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面 金額	簿価単 価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	日本	親投資信託 受益証券	21,725,006	1.1507 24,999,239	1.1556 25,105,416	38.24
2	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	6,538,311	2.0256 13,244,175	2.2927 14,990,385	22.83
3	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	16,922,620	0.4725 7,997,226	0.6433 10,886,321	16.58
4	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	5,846,453	1.0615 6,206,233	1.3812 8,075,120	12.30
5	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	2,240,080	1.2101 2,710,877	1.4693 3,291,349	5.01
6	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	1,984,775	1.3626 2,704,652	1.6015 3,178,617	4.84

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.80%
合計	99.80%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成20年12月18日)	6,547,046	6,547,046	0.7390	0.7390
第2計算期間末 (平成21年12月18日)	27,850,148	27,850,148	0.8079	0.8079
第3計算期間末 (平成22年12月20日)	36,256,038	36,256,038	0.8249	0.8249
第4計算期間末 (平成23年12月19日)	40,591,212	40,591,212	0.7738	0.7738
平成24年7月末日	45,191,520	-	0.8166	-
8月末日	47,280,214	-	0.8221	-
9月末日	48,490,440	-	0.8313	-
10月末日	50,159,577	-	0.8409	-
11月末日	53,150,594	-	0.8636	-
第5計算期間末 (平成24年12月18日)	54,675,911	54,675,911	0.8815	0.8815
12月末日	56,116,627	-	0.9044	-
平成25年1月末日	60,675,612	-	0.9526	-
2月末日	61,846,014	-	0.9673	-
3月末日	64,907,679	-	1.0037	-
4月末日	70,310,011	-	1.0498	-
5月末日	63,599,222	-	1.0430	-
6月末日	64,108,720	-	1.0227	-
7月末日	65,656,922	-	1.0285	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000

平成24年12月19日～ 平成25年6月18日	-
----------------------------	---

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	26.1
第2計算期間	9.3
第3計算期間	2.1
第4計算期間	6.2
第5計算期間	13.9
平成24年12月19日～ 平成25年6月18日	14.3

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	10,442,373	2,582,699
第2計算期間	28,650,369	3,037,036
第3計算期間	11,533,326	2,056,679
第4計算期間	11,003,989	2,494,623
第5計算期間	16,094,256	6,525,749
平成24年12月19日～ 平成25年6月18日	8,690,936	9,014,310

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

## (参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

## (1) 投資状況（平成25年7月31日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	113,696,701,520	99.32
内 日本	113,696,701,520	99.32
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	782,455,501	0.68
純資産総額	114,479,157,021	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）	821,615,000	0.72
内 日本	821,615,000	0.72

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(注3) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

## (2) 投資資産（平成25年7月31日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、 口数 または 額 面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	929,700	3,260.41 3,031,208,500	5,970.00 5,550,309,000	4.85
2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	5,404,000	388.29 2,098,332,000	601.00 3,247,804,000	2.84
3	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	539,600	2,606.37 1,406,399,800	4,485.00 2,420,106,000	2.11
4	本田技研	日本	株式	輸送用機器	609,600	2,676.29 1,631,471,400	3,630.00 2,212,848,000	1.93
5	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	346,300	3,134.63 1,085,524,498	6,240.00 2,160,912,000	1.89
6	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	9,212,300	135.09 1,244,522,300	203.00 1,870,096,900	1.63
7	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	448,800	2,430.30 1,090,719,380	3,425.00 1,537,140,000	1.34
8	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	300,200	3,601.93 1,081,301,600	4,935.00 1,481,487,000	1.29
9	キヤノン	日本	株式	電気機器	420,200	2,861.88 1,202,565,760	3,025.00 1,271,105,000	1.11
10	三菱地所	日本	株式	不動産業	499,000	1,504.00 750,496,000	2,491.00 1,243,009,000	1.09
11	武田薬品	日本	株式	医薬品	283,200	3,736.81 1,058,267,200	4,375.00 1,239,000,000	1.08
12	日立	日本	株式	電気機器	1,737,000	479.91 833,607,740	658.00 1,142,946,000	1.00
13	ファナック	日本	株式	電気機器	75,300	13,990.08 1,053,453,600	14,860.00 1,118,958,000	0.98
14	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	297,800	2,331.21 694,236,400	3,700.00 1,101,860,000	0.96
15	野村ホールディングス	日本	株式	証券、商品先物 取引業	1,461,800	305.55 446,657,000	747.00 1,091,964,600	0.95
16	KDDI	日本	株式	情報・通信業	201,600	2,885.00 581,616,000	5,410.00 1,090,656,000	0.95
17	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	133,000	5,024.09 668,205,425	7,890.00 1,049,370,000	0.92
18	三井不動産	日本	株式	不動産業	336,000	1,610.49 541,126,910	2,963.00 995,568,000	0.87
19	三菱商事	日本	株式	卸売業	555,200	1,549.93 860,523,841	1,789.00 993,252,800	0.87

20	ソニー	日本	株式	電気機器	455,300	1,055.21 480,439,700	2,068.00 941,560,400	0.82
21	日産自動車	日本	株式	輸送用機器	912,700	727.61 664,096,400	1,027.00 937,342,900	0.82
22	新日鐵住金	日本	株式	鉄鋼	3,197,000	175.23 560,210,594	285.00 911,145,000	0.80
23	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	日本	株式	情報・通信業	5,860	128,378.26 752,296,614	149,500.00 876,070,000	0.77
24	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	165,000	3,955.00 652,575,000	5,250.00 866,250,000	0.76
25	東京海上HD	日本	株式	保険業	275,400	2,112.76 581,854,862	3,135.00 863,379,000	0.75
26	信越化学	日本	株式	化学	135,500	4,633.97 627,903,500	6,120.00 829,260,000	0.72
27	ブリヂストン	日本	株式	ゴム製品	237,100	1,912.85 453,537,500	3,480.00 825,108,000	0.72
28	三井物産	日本	株式	卸売業	612,000	1,185.04 725,245,200	1,315.00 804,780,000	0.70
29	デンソー	日本	株式	輸送用機器	178,200	2,785.82 496,433,400	4,460.00 794,772,000	0.69
30	小松製作所	日本	株式	機械	352,700	1,671.57 589,566,000	2,188.00 771,707,600	0.67

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	99.32%
合計	99.32%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.08%
鉱業	0.45%
建設業	2.46%
食料品	3.96%
繊維製品	0.75%
パルプ・紙	0.27%
化学	5.40%
医薬品	4.39%
石油・石炭製品	0.65%
ゴム製品	0.96%
ガラス・土石製品	0.91%
鉄鋼	1.73%
非鉄金属	1.01%
金属製品	0.66%
機械	4.98%
電気機器	11.32%
輸送用機器	11.90%

精密機器	1.33%
その他製品	1.39%
電気・ガス業	2.57%
陸運業	3.99%
海運業	0.34%
空運業	0.62%
倉庫・運輸関連業	0.23%
情報・通信業	6.87%
卸売業	4.46%
小売業	4.38%
銀行業	10.18%
証券、商品先物取引業	1.84%
保険業	2.38%
その他金融業	1.29%
不動産業	3.48%
サービス業	2.09%
合計	99.32%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物取引	日本	TOPIX先物 2013年9月	買建	73	794,216,745	821,615,000	0.72%

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（平成25年7月31日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		62,723,824,017	96.57
	内 香港	851,998,073	1.31
	内 シンガポール	461,155,832	0.71
	内 イスラエル	144,367,404	0.22
	内 ノルウェー	246,324,249	0.38
	内 スウェーデン	960,895,896	1.48
	内 デンマーク	335,567,733	0.52
	内 イギリス	6,305,619,490	9.71
	内 アイルランド	92,207,400	0.14

内 オランダ	783,364,951	1.21
内 ベルギー	329,219,834	0.51
内 フランス	2,755,455,863	4.24
内 ドイツ	2,548,393,406	3.92
内 スイス	2,644,980,137	4.07
内 ポルトガル	53,507,226	0.08
内 スペイン	874,466,592	1.35
内 イタリア	602,696,480	0.93
内 フィンランド	233,345,107	0.36
内 オーストリア	85,501,007	0.13
内 ギリシャ	9,608,744	0.01
内 カナダ	3,022,541,783	4.65
内 アメリカ	37,213,934,520	57.29
内 オーストラリア	2,138,081,837	3.29
内 ニュージーランド	30,590,453	0.05
投資証券	1,314,874,826	2.02
内 香港	28,842,000	0.04
内 シンガポール	20,839,371	0.03
内 イギリス	85,504,075	0.13
内 オランダ	8,640,236	0.01
内 フランス	92,348,180	0.14
内 アメリカ	912,042,621	1.40
内 オーストラリア	166,658,343	0.26
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	916,148,398	1.41
純資産総額	64,954,847,241	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）	908,794,568	1.40
内 アメリカ	908,794,568	1.40

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(注3) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

## (2) 投資資産（平成25年7月31日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

銘柄名	地域	種類	業種	株数、 口数 または 額 面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)

1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	22,900	57,804.42 1,323,721,420	44,461.62 1,018,171,226	1.57
2	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	109,555	8,642.80 946,863,006	9,200.88 1,008,002,934	1.55
3	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	68,200	6,789.09 463,016,456	9,138.11 623,219,348	0.96
4	GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	株式	資本財・サービス	254,500	2,072.43 527,433,537	2,400.99 611,054,093	0.94
5	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	194,300	2,665.12 517,837,361	3,123.84 606,963,666	0.93
6	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	47,618	10,375.88 494,078,806	12,336.50 587,439,571	0.90
7	GOOGLE INC-CL A	アメリカ	株式	情報技術	6,500	67,860.57 441,093,713	87,381.43 567,979,318	0.87
8	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	80,900	6,442.07 521,172,588	6,542.86 529,317,374	0.81
9	PROCTER & GAMBLE CO	アメリカ	株式	生活必需品	66,637	6,816.56 454,235,109	7,889.55 525,736,290	0.81
10	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	122,872	3,252.33 399,620,636	4,242.94 521,338,622	0.80
11	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	464,700	944.05 438,701,206	1,100.39 511,355,016	0.79
12	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	94,020	4,042.85 380,109,472	5,426.76 510,224,577	0.79
13	INTL BUSINESS MACHINES CORP	アメリカ	株式	情報技術	26,000	18,785.26 488,416,822	19,224.66 499,841,181	0.77
14	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	161,863	2,437.28 394,506,748	2,910.03 471,026,769	0.73
15	AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	134,295	3,327.85 446,914,207	3,473.99 466,539,971	0.72
16	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	17,700	19,227.56 340,327,918	24,430.19 432,414,452	0.67
17	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	57,350	6,083.80 348,906,188	6,991.36 400,954,639	0.62
18	COCA-COLA CO	アメリカ	株式	生活必需品	98,500	3,724.09 366,823,614	3,954.58 389,526,682	0.60
19	CITIGROUP INC	アメリカ	株式	金融	74,523	3,453.39 257,357,490	5,078.58 378,471,196	0.58
20	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	265,701	964.12 256,169,349	1,424.12 378,390,533	0.58
21	VODAFONE GROUP PLC	イギリス	株式	電気通信サービス	1,226,737	239.60 293,926,688	291.61 357,736,099	0.55
22	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	アメリカ	株式	生活必需品	40,500	8,859.56 358,812,439	8,745.79 354,204,641	0.55
23	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	73,921	4,385.15 324,155,176	4,712.74 348,370,749	0.54
24	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	69,300	4,316.50 299,133,505	4,945.19 342,701,916	0.53



25	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	129,900	1,864.50 242,198,654	2,517.71 327,050,997	0.50
26	BP PLC	イギリス	株式	エネルギー	481,500	644.21 310,189,860	674.70 324,871,700	0.50
27	PEPSICO INC	アメリカ	株式	生活必需品	37,900	6,896.00 261,358,582	8,347.58 316,373,616	0.49
28	WAL-MART STORES INC	アメリカ	株式	生活必需品	41,100	6,947.00 285,521,963	7,639.45 313,981,444	0.48
29	SANOFI	フランス	株式	ヘルスケア	29,925	9,034.57 270,359,612	10,414.40 311,651,040	0.48
30	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A	イギリス	株式	エネルギー	93,900	3,120.18 292,985,489	3,306.27 310,459,354	0.48

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	96.57%
投資証券	2.02%
合計	98.59%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	10.45%
素材	5.54%
資本財・サービス	10.13%
一般消費財・サービス	10.89%
生活必需品	10.70%
ヘルスケア	11.67%
金融	18.70%
情報技術	11.59%
電気通信サービス	3.50%
公益事業	3.38%
その他	0.00%
合計	96.57%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物取引	アメリカ	S&P500 2013年9月	買建	22	875,600,863	908,794,568	1.40%

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

(参考) ダイワJ - R E I Tマザーファンド

(1) 投資状況 (平成25年7月31日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	97,351,715,350	98.96
内 日本	97,351,715,350	98.96
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,026,204,276	1.04
純資産総額	98,377,919,626	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 投資資産 (平成25年7月31日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金 額	簿価単 価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド	日本	投資証券	1,252,216.42 11,101 13,900,854,513	1,067,000.00	11,844,767,000	12.04
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	1,227,519.15 9,531 11,699,485,036	1,036,000.00	9,874,116,000	10.04
3	日本リテールファンド	日本	投資証券	207,904.66 33,354 6,934,452,338	193,000.00	6,437,322,000	6.54
4	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	143,832.81 38,027 5,469,530,554	121,800.00	4,631,688,600	4.71
5	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	239,415.68 19,892 4,762,456,856	198,100.00	3,940,605,200	4.01
6	日本プロロジスリート	日本	投資証券	967,842.97 4,475 4,331,097,339	850,000.00	3,803,750,000	3.87
7	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	348,316.65 13,235 4,609,970,870	268,300.00	3,550,950,500	3.61
8	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	954,725.85 3,978 3,797,899,469	833,000.00	3,313,674,000	3.37
9	森トラスト総合リート	日本	投資証券	1,020,026.86 3,882 3,959,744,288	841,000.00	3,264,762,000	3.32
10	G L P 投資法人	日本	投資証券	100,693.54 29,480 2,968,445,795	96,000.00	2,830,080,000	2.88
11	オリックス不動産投資	日本	投資証券	127,169.06 25,525 3,245,990,421	109,500.00	2,794,987,500	2.84
12	N M F 投資法人	日本	投資証券	99,168.62 26,400 2,618,051,596	97,100.00	2,563,440,000	2.61

13	野村不動産オフィスF	日本	投資証券	604,910.30 5,976 3,614,943,968	428,500.00 2,560,716,000	2.60
14	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	734,871.20 3,701 2,719,758,345	644,000.00 2,383,444,000	2.42
15	A P I 投資法人	日本	投資証券	857,356.54 3,293 2,823,275,097	701,000.00 2,308,393,000	2.35
16	森ヒルズリート	日本	投資証券	632,016.01 4,085 2,581,785,425	548,000.00 2,238,580,000	2.28
17	産業ファンド	日本	投資証券	985,555.13 2,509 2,472,757,825	877,000.00 2,200,393,000	2.24
18	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	日本	投資証券	428,929.61 5,645 2,421,307,693	379,000.00 2,139,455,000	2.17
19	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	1,044,954.87 2,374 2,480,722,885	870,000.00 2,065,380,000	2.10
20	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	644,789.30 3,609 2,327,044,597	521,000.00 1,880,289,000	1.91
21	ケネディクス不動産投資法人	日本	投資証券	422,018.42 4,597 1,940,018,712	390,000.00 1,792,830,000	1.82
22	福岡リート投資法人	日本	投資証券	797,260.04 2,214 1,765,133,734	745,000.00 1,649,430,000	1.68
23	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	36,111.86 42,050 1,518,503,721	37,750.00 1,587,387,500	1.61
24	日本賃貸住宅投資法人	日本	投資証券	77,962.48 21,349 1,664,421,132	66,800.00 1,426,113,200	1.45
25	東急リアル・エステート	日本	投資証券	623,429.89 2,782 1,734,381,978	510,000.00 1,418,820,000	1.44
26	大和ハウスリート	日本	投資証券	768,840.17 1,966 1,511,539,793	672,000.00 1,321,152,000	1.34
27	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	446,500.00 3,499 1,562,303,500	359,000.00 1,256,141,000	1.28
28	プレミア投資法人	日本	投資証券	467,210.96 3,155 1,474,050,604	378,500.00 1,194,167,500	1.21
29	野村不レジデンシャル	日本	投資証券	551,090.60 2,421 1,334,190,353	489,500.00 1,185,079,500	1.20
30	積水ハウス・S I 投資法人	日本	投資証券	505,865.23 2,560 1,295,015,001	449,500.00 1,150,720,000	1.17

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	98.96%
合計	98.96%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（平成25年7月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	815,529,488	98.27
内 香港	15,387,334	1.85
内 シンガポール	30,371,583	3.66
内 イスラエル	204,036	0.02
内 イギリス	48,830,868	5.88
内 オランダ	9,016,050	1.09
内 ベルギー	4,573,815	0.55
内 フランス	41,985,993	5.06
内 ドイツ	1,122,917	0.14
内 イタリア	808,560	0.10
内 カナダ	22,655,788	2.73
内 アメリカ	554,906,668	66.86
内 オーストラリア	83,038,091	10.01
内 ニュージーランド	2,627,785	0.32
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	14,396,899	1.73
純資産総額	829,926,387	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 投資資産（平成25年7月31日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面 金額	簿価単 価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	3,447 52,073,315	15,106.77	15,861.49 54,674,582	6.59
2	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	投資証券	1,050 24,848,230	23,664.93	23,883.68 25,077,867	3.02
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	1,600 22,444,608	14,027.79	15,647.68 25,036,293	3.02
4	WESTFIELD GROUP	オースト ラリア	投資証券	22,400 20,986,655	936.85	1,006.81 22,552,622	2.72

5	HCP INC	アメリカ	投資証券	5,000	4,459.50 22,297,654	4,381.23 21,906,168	2.64
6	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	3,279	6,340.57 20,790,765	6,652.76 21,814,421	2.63
7	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	5,546	3,472.81 19,260,491	3,815.31 21,159,720	2.55
8	HEALTH CARE REIT INC	アメリカ	投資証券	3,100	6,017.89 18,655,699	6,432.08 19,939,468	2.40
9	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	3,500	5,502.97 19,260,519	5,655.29 19,793,525	2.38
10	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	1,700	10,065.55 17,111,576	10,663.25 18,127,538	2.18
11	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	1,300	13,137.32 17,078,621	13,461.48 17,499,924	2.11
12	VORNADO REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	1,864	7,521.55 14,020,277	8,450.57 15,751,868	1.90
13	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	8,200	1,475.12 12,096,383	1,767.40 14,492,693	1.75
14	LAND SECURITIES GROUP PLC	イギリス	投資証券	8,650	1,218.03 10,536,408	1,410.24 12,198,658	1.47
15	LINK REIT	香港	投資証券	25,000	530.46 13,261,924	480.70 12,017,500	1.45
16	GENERAL GROWTH PROPERTIES	アメリカ	投資証券	4,977	1,890.39 9,408,664	2,102.83 10,465,811	1.26
17	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	4,500	1,889.80 8,504,124	2,196.99 9,886,464	1.19
18	BRITISH LAND CO PLC	イギリス	投資証券	11,050	822.53 9,089,676	889.34 9,827,279	1.18
19	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	2,217	3,986.36 8,837,854	4,335.13 9,610,997	1.16
20	MACERICH CO	アメリカ	投資証券	1,500	5,586.73 8,380,151	6,229.06 9,343,591	1.13
21	WESTFIELD RETAIL TRUST	オーストラリア	投資証券	33,800	266.18 8,998,755	270.96 9,158,549	1.10
22	SL GREEN REALTY CORP	アメリカ	投資証券	1,000	7,409.55 7,409,552	8,945.87 8,945,877	1.08
23	STOCKLAND	オーストラリア	投資証券	25,100	305.67 7,673,976	324.97 8,156,960	0.98
24	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	1,400	6,281.53 8,794,176	5,564.07 7,789,710	0.94
25	FEDERAL REALTY INVS TRUST	アメリカ	投資証券	700	10,052.21 7,036,553	10,413.15 7,289,208	0.88
26	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	16,740	411.84 6,894,993	418.84 7,011,407	0.84
27	UDR INC	アメリカ	投資証券	2,800	2,279.67 6,383,243	2,501.04 7,002,912	0.84
28	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	400	13,782.20 5,512,881	16,090.02 6,436,010	0.78

29	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	900	6,479.16 5,831,248	7,025.47 6,322,923	0.76
30	HAMMERSON PLC	イギリス	投資証券	7,900	702.65 5,551,265	782.47 6,181,556	0.74

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	98.27%
合計	98.27%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

#### (1) 投資状況（平成25年7月31日現在）

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	10,546,958,790	73.47
内 日本	10,546,958,790	73.47
地方債証券	1,236,810,168	8.62
内 日本	1,236,810,168	8.62
特殊債証券	1,241,479,936	8.65
内 日本	1,241,479,936	8.65
社債証券	1,225,757,788	8.54
内 日本	1,225,757,788	8.54
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	104,066,511	0.72
純資産総額	14,355,073,193	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

#### (2) 投資資産（平成25年7月31日現在）

投資有価証券の主要銘柄

##### イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単 価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	3 2 2 2年国債	日本	国債証券	180,000,000	100.00 180,015,600	99.99 987,400	0.100000 2014/11/15	1.25
2	1 0 5 5年国債	日本	国債証券	180,000,000	100.18 180,324,000	99.96 929,800	0.200000 2017/06/20	1.25
3	3 2 8 10年国債	日本	国債証券	170,000,000	98.71 167,822,560	98.34 183,100	0.600000 2023/03/20	1.16
4	2 8 8 10年国債	日本	国債証券	148,000,000	107.30 158,805,480	106.04 940,680	1.700000 2017/09/20	1.09
5	3 2 5 10年国債	日本	国債証券	155,000,000	100.62 155,969,280	100.47 728,500	0.800000 2022/09/20	1.08
6	9 2 5年国債	日本	国債証券	140,000,000	100.58 140,817,800	100.39 550,200	0.300000 2015/09/20	0.98
7	3 1 0 10年国債	日本	国債証券	130,000,000	104.14 135,383,880	103.23 199,000	1.000000 2020/09/20	0.93
8	2 8 7 10年国債	日本	国債証券	116,000,000	107.87 125,130,880	106.52 572,480	1.900000 2017/06/20	0.86
9	3 2 9 2年国債	日本	国債証券	123,000,000	100.13 123,164,820	100.15 194,340	0.200000 2015/06/15	0.86
10	3 2 7 2年国債	日本	国債証券	120,000,000	99.98 119,985,600	99.98 979,600	0.100000 2015/04/15	0.84
11	1 0 7 5年国債	日本	国債証券	120,000,000	100.15 120,183,000	99.80 764,800	0.200000 2017/12/20	0.83
12	8 8 5年国債	日本	国債証券	118,000,000	100.92 119,088,680	100.62 738,680	0.500000 2015/03/20	0.83
13	9 5 5年国債	日本	国債証券	117,000,000	101.60 118,872,270	101.24 456,650	0.600000 2016/03/20	0.83
14	8 9 5年国債	日本	国債証券	115,000,000	100.77 115,888,800	100.53 615,250	0.400000 2015/06/20	0.81
15	3 2 4 10年国債	日本	国債証券	114,000,000	101.11 115,273,500	100.62 712,500	0.800000 2022/06/20	0.80
16	8 6 5年国債	日本	国債証券	110,000,000	100.87 110,966,600	100.56 616,000	0.600000 2014/09/20	0.77
17	3 7 8 東北電力	日本	社債券	100,000,000	110.78 110,784,700	108.69 693,100	3.850000 2016/04/25	0.76
18	3 1 9 10年国債	日本	国債証券	105,000,000	104.26 109,477,800	103.41 583,650	1.100000 2021/12/20	0.76
19	2 7 2 10年国債	日本	国債証券	105,000,000	103.62 108,803,100	102.73 871,750	1.400000 2015/09/20	0.75
20	5 日本政策投資C O	日本	特殊債券	100,000,000	107.30 107,302,000	107.27 270,900	1.745000 2019/03/20	0.75
21	3 0 国際協力銀行	日本	特殊債券	100,000,000	106.66 106,662,000	106.94 949,200	1.870000 2018/03/20	0.75
22	2 1 - 6 大阪市公債	日本	地方債証券	100,000,000	107.74 107,746,700	106.78 787,400	1.570000 2019/11/25	0.74
23	2 1 - 2 埼玉県公債	日本	地方債証券	100,000,000	107.80 107,802,800	106.78 786,000	1.570000 2019/05/27	0.74

24	2 政保地方公営機	日本	特殊債券	100,000,000	107.76 107,764,106	106.67 106,670,700	1.600000 2018/11/16	0.74
25	2 0 - 6 北海道公債	日本	地方債証券	100,000,000	107.93 107,939,106	106.64 106,645,100	1.720000 2018/08/29	0.74
26	7 6 共同発行地方	日本	地方債証券	100,000,000	106.78 106,787,606	105.86 105,868,400	1.400000 2019/07/25	0.74
27	2 9 3 大阪府公債	日本	地方債証券	100,000,000	107.04 107,048,206	105.69 105,699,800	2.100000 2016/08/30	0.74
28	3 0 7 1 0 年国債	日本	国債証券	100,000,000	106.53 106,535,106	105.54 105,540,000	1.300000 2020/03/20	0.74
29	2 6 公営企業	日本	特殊債券	100,000,000	106.75 106,755,206	105.49 105,492,600	1.780000 2017/03/24	0.73
30	6 5 3 東京都公債	日本	地方債証券	100,000,000	106.65 106,652,206	105.41 105,417,300	1.540000 2017/12/20	0.73

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	73.47%
地方債証券	8.62%
特殊債券	8.65%
社債券	8.54%
合計	99.28%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

#### (1) 投資状況（平成25年7月31日現在）

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	135,537,869,347	97.43
内 ユーロ	58,065,709,011	41.74
内 シンガポール	511,398,816	0.37
内 マレーシア	690,628,031	0.50
内 ノルウェー	447,997,443	0.32



内 スウェーデン	744,135,666	0.53
内 デンマーク	1,158,803,796	0.83
内 イギリス	10,237,289,310	7.36
内 スイス	509,750,077	0.37
内 ポーランド	1,053,154,304	0.76
内 カナダ	3,506,588,078	2.52
内 アメリカ	54,494,751,757	39.17
内 メキシコ	1,400,148,030	1.01
内 南アフリカ	756,863,568	0.54
内 オーストラリア	1,960,651,460	1.41
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,581,891,293	2.57
純資産総額	139,119,760,640	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	1,607,266,375	1.16
内 日本	1,607,266,375	1.16

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(注3) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

## (2) 投資資産(平成25年7月31日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単 価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,358,000	120.00 680,163,661	117.36 147,071	4.250000 2023/10/25	0.48
2	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,619,000	109.62 658,493,656	107.59 318,180	3.000000 2022/04/25	0.46
3	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,630,000	117.84 650,717,683	111.15 792,761	3.625000 2020/02/15	0.44
4	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,843,000	105.14 602,560,599	103.74 526,147	2.500000 2015/03/31	0.43
5	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,259,000	117.10 604,010,168	110.27 791,133	3.500000 2020/05/15	0.41
6	ITALIAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,052,000	103.27 544,238,129	104.33 780,080	4.250000 2019/02/01	0.40
7	ITALIAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,963,000	103.43 533,102,636	103.97 874,828	3.750000 2016/08/01	0.39
8	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,590,000	114.26 533,461,386	112.73 355,279	3.500000 2020/04/25	0.38
9	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,752,000	107.95 526,783,349	106.01 273,250	3.000000 2015/10/25	0.37

10	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,184,000	99.98 508,365,508	100.09 919,575	0.250000 2014/09/30	0.37
11	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,156,000	99.98 505,639,595	100.10 231,465	0.250000 2014/10/31	0.36
12	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,921,000	104.67 505,196,929	103.40 071,490	2.375000 2015/02/28	0.36
13	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,635,000	111.67 507,675,493	108.46 096,395	3.250000 2017/03/31	0.35
14	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,522,000	109.83 503,074,789	107.63 002,575	3.250000 2016/04/25	0.35
15	ITALIAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,598,000	103.21 482,940,488	104.26 853,287	4.250000 2019/09/01	0.35
16	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,622,000	104.71 493,227,483	102.72 858,128	3.000000 2014/07/12	0.35
17	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,230,000	116.05 487,481,880	114.31 172,300	3.750000 2021/04/25	0.35
18	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,288,000	113.39 484,868,426	110.99 619,503	3.750000 2017/04/25	0.34
19	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,111,000	101.92 510,916,670	94.60 222,401	1.750000 2022/05/15	0.34
20	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,827,000	99.96 473,261,473	100.08 834,577	0.250000 2014/12/15	0.34
21	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	5,191,000	100.40 511,200,873	93.05 748,517	1.625000 2022/08/15	0.34
22	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,658,000	104.02 475,254,276	103.02 667,416	1.875000 2015/06/30	0.34
23	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,788,000	99.81 468,742,968	99.82 780,531	0.250000 2015/08/15	0.34
24	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,417,000	114.42 495,728,561	106.80 712,934	3.125000 2021/05/15	0.33
25	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,527,000	110.68 491,459,812	104.21 700,903	2.625000 2020/08/15	0.33
26	ITALIAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,118,000	109.70 444,845,202	113.46 099,977	6.000000 2031/05/01	0.33
27	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	4,509,000	110.65 489,368,159	103.86 344,245	2.625000 2020/11/15	0.33
28	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,507,000	143.96 469,376,791	139.20 844,467	5.750000 2032/10/25	0.33
29	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,623,000	137.27 468,274,058	132.99 663,839	5.500000 2029/04/25	0.33
30	ITALIAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,963,000	115.42 444,767,552	117.48 695,258	6.500000 2027/11/01	0.33

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.43%
合計	97.43%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

## 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	スウェーデン・クローネ 買/円売 2013年8月	買建	526,000	7,735,235	7,868,954	0.01%
		ユーロ買/円売 2013年8月	買建	5,379,000	695,107,180	699,485,167	0.50%
		ポーランド・ズロチ買/円 売 2013年8月	買建	368,000	10,948,441	11,323,360	0.01%
		シンガポール・ドル買/円 売 2013年8月	買建	70,000	5,481,336	5,399,100	0.00%
		豪ドル買/円売 2013年8月	買建	227,000	20,741,217	20,091,770	0.01%
		メキシコ・ペソ買/円売 2013年8月	買建	1,855,000	14,088,539	14,246,400	0.01%
		米ドル買/円売 2013年8月	買建	6,698,000	664,206,422	656,872,849	0.47%
		デンマーク・クローネ買/ 円売 2013年8月	買建	704,000	12,190,323	12,284,800	0.01%
		英ポンド買/円売 2013年8 月	買建	805,000	121,439,664	120,307,250	0.09%
		ノルウェー・クローネ買/ 円売 2013年8月	買建	278,000	4,549,538	4,589,780	0.00%
		南アフリカ・ランド買/円 売 2013年8月	買建	803,000	7,952,592	8,021,965	0.01%
		スイス・フラン買/円売 2013年8月	買建	50,000	5,229,265	5,276,500	0.00%
		カナダ・ドル買/円売 2013 年8月	買建	436,000	41,194,591	41,498,480	0.03%

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

[次へ](#)

## (参考情報)

2013年7月31日現在

※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	10,285円
純資産総額	65百万円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	0.6%
3カ月間	-2.0%
6カ月間	8.0%
1年間	25.9%
3年間	27.7%
5年間	5.4%
設定来	2.9%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。  
※基準価額の計算において信託報酬は控除しています。

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 08年12月	第2期 09年12月	第3期 10年12月	第4期 11年12月	第5期 12年12月				
分配金	0円	0円	0円	0円	0円				

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率
国内債券	288	38.0%	日本円	60.0%	直接利回り(%)	トヨタ自動車	日本	0.8%
外国債券	682	22.2%	米ドル	19.9%	最終利回り(%)	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.5%
国内株式・先物	1,294	16.6%	ユーロ	11.8%	修正デュレーション	三井住友フィナンシャルG	日本	0.4%
外国株式・先物	1,179	12.0%	英ポンド	3.2%	残存年数	本田技研	日本	0.3%
外国リート	249	5.2%	カナダ・ドル	1.3%	債券格付別構成	ソフトバンク	日本	0.3%
国内リート	40	4.8%	豪ドル	1.3%	AAA	日本ビルファンド	日本	0.6%
			スイス・フラン	0.6%	AA	ジャパンリアルエステイト	日本	0.5%
			シンガポール・ドル	0.4%	A	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	0.4%
			スウェーデン・クローネ	0.3%	BBB	日本リテールファンド	日本	0.3%
コール・ローン、その他		1.5%	その他	1.4%	BB以下・無格付	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	0.2%
合計	3,732	-	合計	100.0%	合計	合計		4.2%

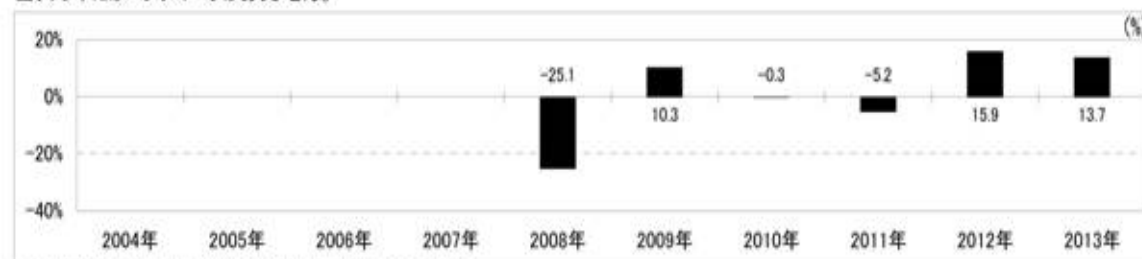
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を3.1%保有しております。

※債券格付別構成について、日系発行体はR&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの順で格付けを採用し、海外発行体はMoody's、S&Pの格付けの高い方を採用し、算出しています。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2008年は設定日(2月28日)から年末、2013年は7月31日までの騰落率を表しています。

### 第3 【ファンドの経理状況】

#### 1 【財務諸表】

原有価証券届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 1 財務諸表」の末尾に、以下の中間財務諸表を追加します。

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（平成24年12月19日から平成25年6月18日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

DCダイワ・ターゲットイヤー2020

[次へ](#)

## (1) 中間貸借対照表

	当中間計算期間末 平成25年6月18日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		340,805
親投資信託受益証券		62,072,309
流動資産合計		62,413,114
資産合計		62,413,114
負債の部		
流動負債		
未払解約金		35,507
未払受託者報酬		16,427
未払委託者報酬		197,572
その他未払費用		2,383
流動負債合計		251,889
負債合計		251,889
純資産の部		
元本等		
元本	1	61,704,153
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		457,072
（分配準備積立金）		4,244,789
元本等合計		62,161,225
純資産合計		62,161,225
負債純資産合計		62,413,114

[次へ](#)

## (2) 中間損益及び剰余金計算書

	当中間計算期間 自 平成24年12月19日 至 平成25年6月18日
	金額（円）
営業収益	
有価証券売買等損益	8,441,650
営業収益合計	8,441,650
営業費用	
受託者報酬	16,427
委託者報酬	197,572
その他費用	2,383
営業費用合計	216,382
営業利益	8,225,268
経常利益	8,225,268
中間純利益	8,225,268
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	1,446,146
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	7,351,616
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,029,566
中間一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	971,936
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	57,630
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	457,072

[次へ](#)

## (3) 中間注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当中間計算期間 自 平成24年12月19日 至 平成25年6月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

## (中間貸借対照表に関する注記)

区分	当中間計算期間末 平成25年6月18日現在
1. 1期首元本額	62,027,527円
期中追加設定元本額	8,690,936円
期中一部解約元本額	9,014,310円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	61,704,153口

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	当中間計算期間 自 平成24年12月19日 至 平成25年6月18日
	該当事項はありません。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 平成25年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

	当中間計算期間末 平成25年6月18日現在
	該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	当中間計算期間末 平成25年6月18日現在



1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0074円 (10,074円)
---------------------------	----------------------

(参考)

当ファンドは、「トピックス・インデックス・マザーファンド」受益証券、「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ」-REITマザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」受益証券、「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)」受益証券及び「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

なお、当ファンドの中間計算期間末日(以下、「期末日」)における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

[次へ](#)

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況  
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成25年6月18日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		1,162,805,054
株式	3	108,969,718,850
派生商品評価勘定		23,044,555
未収入金		17,081,000
未収配当金		850,127,483
流動資産合計		111,022,776,942
資産合計		111,022,776,942
負債の部		
流動負債		
前受金		24,254,000
未払解約金		75,990,000
流動負債合計		100,244,000
負債合計		100,244,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	179,762,399,273
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	68,839,866,331
元本等合計		110,922,532,942
純資産合計		110,922,532,942
負債純資産合計		111,022,776,942

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 平成24年12月19日 至 平成25年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引  個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成25年6月18日現在
1. 1 期首 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	平成24年12月19日 201,568,942,984円 6,134,100,732円 27,940,644,443円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
適格機関投資家専用投信1号	1,689,700,800円
トピックス・インデックスファン ド	8,784,286,140円
ダイワ・トピックス・インデッ クスファンドVA	25,733,192,478円
適格機関投資家専用・ダイワ・ トピックスインデックスファン ドVA2	683,640,260円
ダイワ国内重視バランスファン ド30VA(一般投資家私募)	288,500,715円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	5,514,192,864円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私募)	292,678,035円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	7,431,108,729円
ダイワ・スマートアロケーショ ン・ファンド(適格機関投資家 専用)	2,541,771円
スマート・ミックス・Dガード (為替ヘッジあり)	14,599,617円
DCダイワ日本株式インデック ス	63,407,266,749円
ダイワ・ライフ・バランス30	2,170,465,139円
ダイワ・ライフ・バランス50	1,763,406,725円
ダイワ・ライフ・バランス70	1,463,253,026円
年金ダイワ日本株式インデック ス	2,362,175,016円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	17,087,566円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	31,928,724円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	5,423,454円
ダイワ世界分散バランスファン ド15VA	353,754,525円
ダイワ世界分散バランスファン ド20VA	2,547,379,926円
ダイワ世界分散バランスファン ド20VA(国内株式型)	1,423,916,223円
ダイワ世界分散バランスファン ド25VA	86,670,169円
ダイワ世界分散バランスファン ド30VA	593,324,737円
ダイワ世界分散バランスファン ド30VA(国内株式型)	272,106,638円
ダイワ世界バランスファンド4 0VA	3,019,562,406円
ダイワ世界バランスファンド6 0VA	455,781,351円

ダイワ・バランスファンド35VA	25,004,284,725円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	1,344,720,094円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	2,912,573,304円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	2,042,862,770円
ダイワ国内バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	372,052,175円
ダイワ国内バランスファンド30VA(適格機関投資家専用)	440,857,099円
ダイワライフスタイル25	180,326,998円
ダイワライフスタイル50	552,001,499円
ダイワライフスタイル75	444,227,351円
DC・ダイワ・トピックス・インデックス(確定拠出年金専用ファンド)	16,060,549,475円
計	179,762,399,273円
2. 期末日における受益権の総数	179,762,399,273口
3. 2元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は68,839,866,331円であります。
4. 3差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。
	株式 927,400,000円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成25年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 株式関連

種類	平成25年6月18日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
株価指数 先物取引				

買 建	1,945,891,000	-	1,969,280,000	23,389,000
合計	1,945,891,000	-	1,969,280,000	23,389,000

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	平成25年6月18日現在
1口当たり純資産額	0.6171円
(1万口当たり純資産額)	(6,171円)

[次へ](#)

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況  
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成25年6月18日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金	338,110,876	
コール・ローン	71,641,498	
株式	59,604,032,087	
投資証券	1,284,860,659	
派生商品評価勘定	7,601,192	
未収入金	121,083,818	
未収配当金	126,135,829	
差入委託証拠金	345,860,990	
流動資産合計	61,899,326,949	
資産合計	61,899,326,949	
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	93	
未払解約金	95,946,000	
流動負債合計	95,946,093	
負債合計	95,946,093	
純資産の部		
元本等		
元本	1	47,372,211,770
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	14,431,169,086	
元本等合計	61,803,380,856	
純資産合計	61,803,380,856	
負債純資産合計	61,899,326,949	

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 平成24年12月19日 至 平成25年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>

2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として期末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区分	平成25年6月18日現在
1. 1期首 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	平成24年12月19日 51,632,637,762円 1,425,925,614円 5,686,351,606円
期末元本額の内訳 ファンド名 ダイワ外国株式インデックスV A ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募) ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募) ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募) ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募) DCダイワ外国株式インデックス ダイワ・ライフ・バランス30 ダイワ・ライフ・バランス50 ダイワ・ライフ・バランス70 大和DC海外株式インデックスファンド	1,774,035,076円 75,477,322円 1,153,601,918円 136,634,172円 3,771,108,980円 17,771,147,040円 515,738,299円 556,560,844円 377,984,608円 1,498,745,898円

DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	5,619,141円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	7,931,182円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	1,702,131円
ダイワ世界分散バランスファン ド15VA	88,534,110円
ダイワ世界分散バランスファン ド20VA	1,263,434,093円
ダイワ世界分散バランスファン ド25VA	28,567,889円
ダイワ世界分散バランスファン ド30VA	285,218,661円
ダイワ世界バランスファンド4 0VA	4,154,350,975円
ダイワ世界バランスファンド6 0VA	1,041,692,049円
ダイワ・バランスファンド35 VA	9,255,226,760円
ダイワ・バランスファンド25 VA(適格機関投資家専用)	474,198,522円
ダイワ投信倶楽部外国株式イン デックス	2,996,852,138円
ダイワライフスタイル25	21,544,357円
ダイワライフスタイル50	64,617,930円
ダイワライフスタイル75	51,687,675円
計	47,372,211,770円
2. 期末日における受益権の総数	47,372,211,770口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成25年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と 時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいこ とから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 株式関連

種類	平成25年6月18日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				



株価指数 先物取引				
買 建	805,757,470	-	813,349,797	7,592,327
合計	805,757,470	-	813,349,797	7,592,327

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## 2. 通貨関連

種 類	平成25年6月18日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	143,472,472	-	143,463,700	8,772
アメリカ・ドル	75,863,440	-	75,856,000	7,440
イギリス・ポンド	28,322,825	-	28,321,400	1,425
ユーロ	39,286,207	-	39,286,300	93
合計	143,472,472	-	143,463,700	8,772

## (注) 1. 時価の算定方法

- (1) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

- (2) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、期末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	平成25年6月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3046円 (13,046円)

[次へ](#)

「ダイワ」-REITマザーファンド」の状況  
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成25年6月18日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	729,728,471
投資証券	95,635,726,320
未収配当金	470,112,718
流動資産合計	96,835,567,509
資産合計	96,835,567,509
負債の部	
流動負債	
未払金	672,859,301
未払解約金	2,000,000
流動負債合計	674,859,301
負債合計	674,859,301
純資産の部	
元本等	
元本	1
元本	60,397,764,073
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	35,762,944,135
元本等合計	96,160,708,208
純資産合計	96,160,708,208
負債純資産合計	96,835,567,509

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 平成24年12月19日 至 平成25年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成25年6月18日現在
1. 1期首	平成24年12月19日
期首元本額	42,668,886,025円
期中追加設定元本額	23,210,185,352円
期中一部解約元本額	5,481,307,304円
期末元本額の内訳 ファンド名	

ダイワJ-REITオープン	9,955,509,332円
ダイワJ-REITオープン (毎月分配型)	49,482,592,043円
DC・ダイワJ-REITオープン	954,643,539円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	1,981,453円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	2,690,111円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	347,595円
計	60,397,764,073円
2. 期末日における受益権の総数	60,397,764,073口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成25年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と 時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいこ とから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成25年6月18日現在
該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	平成25年6月18日現在
1口当たり純資産額	1.5921円
(1万口当たり純資産額)	(15,921円)

[次へ](#)

## 「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成25年6月18日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		8,399,578
コール・ローン		3,420,348
投資証券		763,721,459
未収入金		2,174
未収配当金		1,135,889
流動資産合計		776,679,448
資産合計		776,679,448
負債の部		
流動負債		
流動負債合計		-
負債合計		-
純資産の部		
元本等		
元本	1	548,082,508
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		228,596,940
元本等合計		776,679,448
純資産合計		776,679,448
負債純資産合計		776,679,448

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 平成24年12月19日 至 平成25年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引  個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として期末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準  外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。
----------------------------	--

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	平成25年6月18日現在	
1. 1 期首		平成24年12月19日
期首元本額		512,564,161円
期中追加設定元本額		114,300,729円
期中一部解約元本額		78,782,382円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド		542,652,407円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020		2,165,793円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030		2,965,283円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040		299,025円
計		548,082,508円
2. 期末日における受益権の総数		548,082,508口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成25年6月18日現在	
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

	平成25年6月18日現在	
該当事項はありません。		

## （1口当たり情報）

	平成25年6月18日現在	
1口当たり純資産額		1.4171円

(1万口当たり純資産額)

[次へ](#)

## 「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成25年6月18日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	41,435,984
国債証券	10,772,765,880
地方債証券	1,236,425,268
特殊債券	1,139,293,433
社債券	1,225,653,906
未収利息	56,645,822
前払費用	3,160,208
流動資産合計	14,475,380,501
資産合計	14,475,380,501
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,842,000
流動負債合計	1,842,000
負債合計	1,842,000
純資産の部	
元本等	
元本	1 12,548,729,421
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,924,809,080
元本等合計	14,473,538,501
純資産合計	14,473,538,501
負債純資産合計	14,475,380,501

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 平成24年12月19日 至 平成25年6月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券  個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

## （貸借対照表に関する注記）

区分	平成25年6月18日現在
1. 1期首	平成24年12月19日
期首元本額	11,560,180,230円
期中追加設定元本額	1,821,742,422円
期中一部解約元本額	833,193,231円
期末元本額の内訳 ファンド名	

ダイワ・ライフ・バランス30	3,273,146,498円
ダイワ・ライフ・バランス50	1,298,975,926円
ダイワ・ライフ・バランス70	354,727,814円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	331,242,336円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	224,575,159円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	53,827,487円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	20,838,693円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	11,722,597円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	509,467円
ダイワ世界バランスファンド4 0VA	4,227,024,441円
ダイワ世界バランスファンド6 0VA	382,598,828円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	724,068,605円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	1,645,471,570円
計	12,548,729,421円
2. 期末日における受益権の総数	12,548,729,421口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成25年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成25年6月18日現在
該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	平成25年6月18日現在
1口当たり純資産額	1.1534円
(1万口当たり純資産額)	(11,534円)

[次へ](#)



「外国債券インデックスマザーファンド」の状況  
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成25年6月18日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	16,092,303
コール・ローン	1,208,592,495
国債証券	133,293,789,347
未収利息	1,395,558,297
前払費用	35,463,353
流動資産合計	135,949,495,795
資産合計	135,949,495,795
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	47,005,653
未払解約金	46,387,000
流動負債合計	93,392,653
負債合計	93,392,653
純資産の部	
元本等	
元本	1 60,302,958,741
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	75,553,144,401
元本等合計	135,856,103,142
純資産合計	135,856,103,142
負債純資産合計	135,949,495,795

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 平成24年12月19日 至 平成25年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券  個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引  個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として期末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準

外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	平成25年6月18日現在
1. 1 期首	平成24年12月19日
期首元本額	62,378,283,951円
期中追加設定元本額	2,332,692,418円
期中一部解約元本額	4,408,017,628円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ外国債券インデックスV A	2,764,241,752円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	85,930,371円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	640,854,018円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	186,208,475円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	2,048,871,435円
ダイワ・スマートアロケーション・ファンド(適格機関投資家専用)	10,447,215円
先進国債券ファンド(為替ヘッジあり)(FOFs用)(適格機関投資家専用)	4,140,048円
DCダイワ外国債券インデックス	31,813,267,863円
ダイワ・ライフ・バランス30	443,949,811円
ダイワ・ライフ・バランス50	160,658,375円
ダイワ・ライフ・バランス70	87,373,500円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	164,771,472円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	110,557,113円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	28,433,505円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	6,186,550円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	4,355,924円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	243,174円
ダイワ世界バランスファンド40VA	2,864,325,703円
ダイワ世界バランスファンド60VA	307,738,015円

ダイワ・バランスファンド35 VA	10,392,704,699円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	1,423,098,061円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	1,199,524,773円
ダイワ・バランスファンド25 VA(適格機関投資家専用)	599,335,258円
ダイワ投信倶楽部外国債券イン デックス	4,883,637,136円
ダイワライフスタイル25	24,829,261円
ダイワライフスタイル50	37,322,721円
ダイワライフスタイル75	9,952,513円
計	60,302,958,741円
2. 期末日における受益権の総数	60,302,958,741口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成25年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と 時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいこ とから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

種類	平成25年6月18日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	1,146,710,262	-	1,099,704,609	47,005,653
アメリカ・ドル	423,771,728	-	399,476,649	24,295,079
イギリス・ポンド	140,116,728	-	136,967,760	3,148,968
オーストラリア・ ドル	21,927,927	-	20,563,930	1,363,997
カナダ・ドル	75,811,984	-	73,432,263	2,379,721
シンガポール・ ドル	5,591,180	-	5,284,300	306,880
スイス・フラン	5,283,225	-	5,139,500	143,725
スウェーデン・ クローナ	7,705,557	-	7,373,980	331,577

デンマーク・ クローネ	11,856,165	-	11,502,230	353,935
ノルウェー・ クローネ	4,524,088	-	4,366,560	157,528
ポーランド・ ズロチ	10,712,520	-	10,501,920	210,600
メキシコ・ペソ	15,438,589	-	14,555,800	882,789
ユーロ	416,033,809	-	402,874,657	13,159,152
南アフリカ・ ランド	7,936,762	-	7,665,060	271,702
合計	1,146,710,262	-	1,099,704,609	47,005,653

## (注) 1. 時価の算定方法

(1) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、期末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	平成25年6月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.2529円 (22,529円)

## 2 【ファンドの現況】

原有価証券届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 2 ファンドの現況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

## 【純資産額計算書】

平成25年7月31日

資産総額	65,709,626円
負債総額	52,704円
純資産総額（ - ）	65,656,922円
発行済数量	63,838,474口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0285円

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

## 純資産額計算書

平成25年7月31日

資産総額	114,725,489,605円
負債総額	246,332,584円
純資産総額（ - ）	114,479,157,021円
発行済数量	177,952,047,583口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.6433円

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

平成25年7月31日

資産総額	65,292,691,241円
負債総額	337,844,000円
純資産総額（ - ）	64,954,847,241円
発行済数量	47,026,671,367口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.3812円

(参考) ダイワJ-REITマザーファンド

## 純資産額計算書

平成25年7月31日

資産総額	100,995,971,222円
負債総額	2,618,051,596円
純資産総額（ - ）	98,377,919,626円
発行済数量	61,427,387,889口

1 単位当たり純資産額 ( / ) 1.6015円

(参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

純資産額計算書

平成25年7月31日

資産総額	843,403,778円
負債総額	13,477,391円
純資産総額 ( - )	829,926,387円
発行済数量	564,831,628口
1 単位当たり純資産額 ( / )	1.4693円

(参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド ( B P I )

純資産額計算書

平成25年7月31日

資産総額	14,410,625,743円
負債総額	55,552,550円
純資産総額 ( - )	14,355,073,193円
発行済数量	12,421,755,409口
1 単位当たり純資産額 ( / )	1.1556円

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

平成25年7月31日

資産総額	139,561,672,350円
負債総額	441,911,710円
純資産総額 ( - )	139,119,760,640円
発行済数量	60,678,762,820口
1 単位当たり純資産額 ( / )	2.2927円

## 第三部 【委託会社等の情報】

### 第1 【委託会社等の概況】

&nbsp;&nbsp;&nbsp;原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 1 委託会社等の概況

および2 事業の内容及び営業の概況」を次の内容に訂正・更新します。

< 訂正後 >

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

平成25年7月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。取締役は、株主総会において選任され、その任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結のときまでです。

取締役会は、3名以内の代表取締役を選定し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

また、取締役、役付執行役員等から構成される経営会議は、経営全般にかかる基本的事項を審議し、決定します。経営会議は、分科会を設置し、専門的な事項についてはその権限を委ねることができます。

###### 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. ファンド個別会議

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を経営会議の分科会であるファンド個別会議において審議・決定します。

##### ロ. 投資環境検討会

運用最高責任者であるCIO (Chief Investment Officer) が議長となり、原則として月1回投資環境検討会を開催し、投資環境について検討します。

##### ハ. 運用会議

CIOが議長となり、原則として月1回運用会議を開催し、基本的な運用方針を決定します。

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

ファンドマネージャーは、基本計画書に定められた各ファンドの諸方針と運用会議で決定された基本的な運用方針にしたがって運用計画書を作成します。運用部長は、ファンドマネージャーから提示を受けた運用計画書について、基本計画書および運用会議の決定事項との整合性等を確認し、承認します。

#### ホ．ファンド評価会議、運用審査会議およびオペレーショナルリスク・監査会議

ファンド評価会議は、運用実績・運用リスクの状況について、分析・検討を行ない、運用部にフィードバックします。また、運用審査会議は、経営会議の分科会として、ファンドの運用実績を把握し評価するとともに、取締役会から権限を委任され、ファンドの運用リスク管理の状況についての報告を受けて、必要事項を審議・決定します。

さらに、運用が適切に行なわれたかについて、経営会議の分科会であるオペレーショナルリスク・監査会議において法令等の遵守状況に関する報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務等の関連する業務を行なっています。

平成25年7月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	6	98,947
追加型株式投資信託	453	8,789,791
株式投資信託 合計	459	8,888,738
単位型公社債投資信託	-	-
追加型公社債投資信託	17	2,881,680
公社債投資信託 合計	17	2,881,680
総合計	476	11,770,419



## 3 【委託会社等の経理状況】

原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度（平成24年4月1日から平成25年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。
3. 財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

## (1) 【貸借対照表】

（単位：千円）

	前事業年度 （平成24年3月31日現在）	当事業年度 （平成25年3月31日現在）
資産の部		
流動資産		
現金・預金	3,745,233	14,380,327
有価証券	19,655,070	9,427,636
前払金	314	207
前払費用	90,562	142,919
未収入金	11,931	521,825
未収委託者報酬	6,516,540	7,183,011
未収収益	55,102	106,914
貯蔵品	11,888	9,551
繰延税金資産	630,508	491,727
その他	190,450	8,445
流動資産計	30,907,602	32,272,567
固定資産		
有形固定資産	1	1,003,450
建物（純額）		513,162
器具備品（純額）		484,571
リース資産（純額）		-
建設仮勘定		5,715
無形固定資産	2,870,849	3,194,512
ソフトウェア		2,173,517
ソフトウェア仮勘定		684,878
電話加入権		11,850
商標権		132
その他		471

投資その他の資産		16,375,520		15,113,434
投資有価証券		10,034,136		8,342,934
関係会社株式		5,141,069		5,141,069
出資金		136,315		136,315
従業員に対する長期貸付金		112,674		92,527
差入保証金		542,920		1,000,820
長期前払費用		8,478		7,376
投資不動産(純額)	1	409,876	1	402,340
貸倒引当金		9,950		9,950
固定資産計		20,249,820		18,562,205
資産合計		51,157,423		50,834,773

(単位:千円)

	前事業年度 (平成24年3月31日現在)	当事業年度 (平成25年3月31日現在)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
リース債務	-	1,227
預り金	55,551	56,491
未払金	7,194,946	6,795,899
未払収益分配金	17,954	10,333
未払償還金	88,334	113,002
未払手数料	3,386,380	3,764,501
その他未払金	2	2,908,061
未払費用	3,313,011	3,383,551
未払法人税等	963,539	588,040
未払消費税等	229,365	189,139
賞与引当金	307,000	841,300
本社移転関連費用引当金	346,425	-
資産除去債務	292,000	-
その他	87,535	-
流動負債計	12,789,375	11,855,648
<b>固定負債</b>		
リース債務	-	4,494
退職給付引当金	1,670,344	1,935,442
役員退職慰労引当金	68,068	67,410
繰延税金負債	1,782,558	1,740,407
固定負債計	3,520,970	3,747,753
負債合計	16,310,345	15,603,402
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	15,174,272	15,174,272
資本剰余金		
資本準備金	11,495,727	11,495,727
資本剰余金合計	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金	374,297	374,297

その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	7,715,116	7,722,723
利益剰余金合計	8,089,414	8,097,020
株主資本合計	34,759,414	34,767,020
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	33,879	464,350
繰延ヘッジ損益	53,783	-
評価・換算差額等合計	87,663	464,350
純資産合計	34,847,077	35,231,371
負債・純資産合計	51,157,423	50,834,773

## (2) 【損益計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)	当事業年度 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)
営業収益		
委託者報酬	72,931,048	73,498,726
その他営業収益	401,212	526,465
営業収益計	73,332,260	74,025,191
営業費用		
支払手数料	41,050,089	41,213,272
広告宣伝費	709,853	604,864
公告費	699	949
受益証券発行費	74	-
調査費	7,993,144	8,116,701
調査費	878,635	824,915
委託調査費	7,114,509	7,291,786
委託計算費	733,156	807,090
営業雑経費	1,651,996	1,280,599
通信費	205,421	206,564
印刷費	472,511	404,023
協会費	52,117	53,643
諸会費	11,971	11,281
その他営業雑経費	909,973	605,086
営業費用計	52,139,015	52,023,478
一般管理費		
給料	4,452,711	5,264,128
役員報酬	209,630	249,180
給料・手当	3,646,155	3,782,533
賞与	289,926	391,114
賞与引当金繰入額	307,000	841,300
福利厚生費	728,342	809,254
交際費	71,356	55,806
寄付金	591	636
旅費交通費	215,939	196,147
租税公課	171,533	206,178
不動産賃借料	727,939	887,968
退職給付費用	422,030	469,713
役員退職慰労引当金繰入額	27,988	38,970
固定資産減価償却費	1,107,222	1,181,438
諸経費	1,077,041	1,094,627
一般管理費計	9,002,696	10,204,869
営業利益	12,190,548	11,796,843

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)		当事業年度 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)	
営業外収益				
受取配当金	1	74,753	1	257,704
有価証券利息		13,537		11,102
受取利息		2,771		10,598
時効成立分配金・償還金		42,189		21,305
投資有価証券売却益		117,695		279,443
有価証券償還益		68,106		101,052
その他		54,685		44,912
営業外収益計		373,739		726,118
営業外費用				
時効成立後支払分配金・償還金		2,182		19,392
投資有価証券売却損		95,389		36,469
有価証券償還損		67,873		33,338
投資不動産管理費用		16,454		16,271
その他		49,191		23,111
営業外費用計		231,091		128,584
経常利益		12,333,196		12,394,377
特別利益				
投資有価証券売却益		-		39,827
固定資産売却益		-		31
その他		-		16,466
特別利益計		-		56,325
特別損失				
固定資産除却損	2	4,871	2	129,816
減損損失	3	76,217	3	-
有価証券評価損		211,376		-
本社移転関連費用		346,425		1,099,913
その他		19,547		14,428
特別損失計		658,438		1,244,158
税引前当期純利益		11,674,757		11,206,544
法人税、住民税及び事業税		5,254,642		4,286,691
法人税等調整額		602,832		109,902
法人税等合計		4,651,809		4,176,789
当期純利益		7,022,948		7,029,755

## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)	当事業年度 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	15,174,272	15,174,272
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	15,174,272	15,174,272
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高	11,495,727	11,495,727
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	11,495,727	11,495,727
資本剰余金合計		
当期首残高	11,495,727	11,495,727
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	374,297	374,297
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	374,297	374,297
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		
当期首残高	9,874,176	7,715,116
当期変動額		
剰余金の配当	9,182,008	7,022,149
当期純利益	7,022,948	7,029,755
当期変動額合計	2,159,059	7,606
当期末残高	7,715,116	7,722,723
利益剰余金合計		
当期首残高	10,248,473	8,089,414
当期変動額		
剰余金の配当	9,182,008	7,022,149
当期純利益	7,022,948	7,029,755
当期変動額合計	2,159,059	7,606
当期末残高	8,089,414	8,097,020

（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日）	当事業年度 （自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日）
<b>株主資本合計</b>		
当期首残高	36,918,473	34,759,414
当期変動額		
剰余金の配当	9,182,008	7,022,149
当期純利益	7,022,948	7,029,755
当期変動額合計	2,159,059	7,606
当期末残高	34,759,414	34,767,020
<b>評価・換算差額等</b>		
<b>その他有価証券評価差額金</b>		
当期首残高	104,040	33,879
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	137,920	430,470
当期変動額合計	137,920	430,470
当期末残高	33,879	464,350
<b>繰延ヘッジ損益</b>		
当期首残高	85,902	53,783
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	32,119	53,783
当期変動額合計	32,119	53,783
当期末残高	53,783	-
<b>評価・換算差額等合計</b>		
当期首残高	18,137	87,663
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	105,800	376,686
当期変動額合計	105,800	376,686
当期末残高	87,663	464,350
<b>純資産合計</b>		
当期首残高	36,900,336	34,847,077
当期変動額		
剰余金の配当	9,182,008	7,022,149
当期純利益	7,022,948	7,029,755
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	105,800	376,686
当期変動額合計	2,053,258	384,293
当期末残高	34,847,077	35,231,371

## 注記事項

## （重要な会計方針）

## 1．有価証券の評価基準及び評価方法

## （1）子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

## （2）その他有価証券

## 時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

## 時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法により計上しております。

## 3．固定資産の減価償却の方法

## （1）有形固定資産及び投資不動産

## （リース資産を除く）

定率法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 6～47年

器具備品 3～20年

（会計上の見積もりの変更と区別することが困難な会計方針の変更）

当社は、法人税法の改正に伴い、当事業年度より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産について、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。

なお、この変更による当事業年度の損益に与える影響は軽微であります。

## （2）無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づいております。

## （3）長期前払費用

定額法によっております。

## （4）リース資産



リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

#### 4．引当金の計上基準

##### (1) 貸倒引当金

債権の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率法により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財務内容評価法により計上しております。

##### (2) 賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額を計上しております。

##### (3) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に依りて各事業年度ごとに各人別の勤務費用が確定するためであります。

また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

##### (4) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

##### (5) 本社移転関連費用引当金

前事業年度において、本社移転に伴い発生する損失に備えるため、発生が見込まれる固定資産除却損、移転費用について合理的な見積額を計上しております。

#### 5．ヘッジ会計の方法

##### (1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によってヘッジ会計を適用しておりましたが、ヘッジ対象である投資有価証券が売却により消滅したため、ヘッジ会計を終了しております。

##### (2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段・・・株価指数先物

ヘッジ対象・・・投資有価証券

##### (3) ヘッジ方針

価格変動リスクを軽減する目的で、対象資産である投資有価証券の保有残高の範囲内でヘッジを行っております。

##### (4) ヘッジ有効性評価の方法

原則として四半期毎にヘッジ手段の時価変動の累計とヘッジ対象の時価変動の累計を比較し、両者の変動額等を基礎にして、ヘッジ手段の有効性評価を行っております。

## 6. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## (1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜処理によっております。

## (2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## (表示方法の変更)

## (損益計算書)

前事業年度において、「営業外費用」の「その他」に含めていた「時効成立後支払分配金・償還金」及び「投資不動産管理費用」は重要性が増したため当事業年度より区分掲記することとしました。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「営業外費用」の「その他」に表示していた67,829千円は、「時効成立後支払分配金・償還金」2,182千円、「投資不動産管理費用」16,454千円、「その他」49,191千円として組替えております。

## (貸借対照表関係)

## 1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成24年3月31日現在)	当事業年度 (平成25年3月31日現在)
建物	986,089千円	15,528千円
器具備品	2,234,738千円	250,072千円
リース資産	-	409千円
投資建物	712,587千円	724,130千円
投資器具備品	22,398千円	23,691千円

## 2 関係会社項目

関係会社に対する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものがあります。

	前事業年度 (平成24年3月31日現在)	当事業年度 (平成25年3月31日現在)
未払金	3,577,654千円	2,883,398千円

## 3 保証債務

## 前事業年度（平成24年3月31日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,372,770千円に対して保証を行っております。

## 当事業年度（平成25年3月31日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,591,590千円に対して保証を行っております。

## （損益計算書関係）

## 1 関係会社項目

関係会社に対する営業外収益には区分掲記されたもののほか次のものがあります。

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
受取配当金	-	185,280千円

## 2 固定資産除却損の内容は次のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
建物	-	546千円
器具備品	4,812千円	128,892千円
無形固定資産（その他）	-	377千円
投資不動産	59千円	-
計	4,871千円	129,816千円

## 3 減損損失に関する注記

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

当事業年度において、当社は以下の資産グループについて減損損失を計上しました。

場所 千葉県浦安市

用途 賃貸等不動産（浦安寮）

種類 建物及び土地

当社は、浦安寮を大和証券グループ全体の補完的な寮として位置付け、本社と浦安寮の2つのグループピングとしております。

浦安寮については、営業活動から生ずるキャッシュ・フローが継続してマイナスとなっており、減損の兆候が認められたため、当該資産グループの帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失（76,217千円）として特別損失に計上しております。その内訳は、建物17,417千円及び土地58,800千円です。

なお、当該資産グループの回収可能価額は正味売却価額により測定しており、不動産鑑定評価額により評価しております。

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

該当事項はありません。

## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

	当事業年度期首 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608
合 計	2,608	-	-	2,608

2．配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当 の総額 （百万円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
平成23年 6月24日 定時株主総会	普通株式	9,182	3,520	平成23年 3月31日	平成23年 6月27日

（2）基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

平成24年 6月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額 7,022百万円  
 配当の原資 利益剰余金  
 1株当たり配当額 2,692円  
 基準日 平成24年 3月31日  
 効力発生日 平成24年 6月26日

当事業年度（自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

	当事業年度期首 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608
合 計	2,608	-	-	2,608

2．配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当 の総額 （百万円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
平成24年 6月25日 定時株主総会	普通株式	7,022	2,692	平成24年 3月31日	平成24年 6月26日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

平成25年6月24日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	7,027百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	2,694円
基準日	平成25年3月31日
効力発生日	平成25年6月25日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用に関する事業を行っております。資金運用については安全性の高い金融商品に限定しております。また、デリバティブ取引は、事業遂行上生じた市場リスクヘッジのために利用し、投機的な取引は行いません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、投資信託、株式であります。投資信託は余資運用及び事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。株式は上場株式、非上場株式並びに子会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。

未払手数料は投資信託の販売に係る手数料の未払額であります。その他未払金は主に連結納税の親会社へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に係る業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

デリバティブ取引は株式先物取引を行っております。当社ではこれをヘッジ手段として、ヘッジ対象である投資有価証券に関わる価格変動リスクをヘッジしており、繰延ヘッジ処理によってヘッジ会計を適用しておりましたが、ヘッジ対象である投資有価証券が売却により消滅したため、ヘッジ会計の適用を終了しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の重要な会計方針「5. ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

( ) 為替変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに為替変動リスク管理の検討を行っております。

( ) 価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握し財務会議において報告を行っております。また、個別の案件ごとに価格変動リスク管理の検討を行っており、保有している投資信託の一部について株式先物取引を利用し価格変動リスクをヘッジしております。なお、繰延ヘッジ処理によってヘッジ会計を適用してはいたしましたが、ヘッジ対象である投資有価証券が売却により消滅したため、ヘッジ会計の適用を終了しております。

( ) デリバティブ取引

デリバティブ取引に関しては、ヘッジ手段に用いる場合にのみ限定しております。取引の執行・管理については財務リスク管理規程に従って行っており、取引の状況を財務会議において行っております。

信用リスクの管理

発行体の信用リスクは財務リスク管理規程に従い、定期的に財務状況等を把握し財務会議において報告を行っております。

( 4 ) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

「 2 . 金融商品の時価等に関する事項」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

2 . 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（ <注 2>参照のこと）。

前事業年度（平成24年 3月31日現在）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
( 1 ) 現金・預金	3,745,233	3,745,233	-
( 2 ) 未収委託者報酬	6,516,540	6,516,540	-
( 3 ) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	28,525,516	28,525,516	-
資産計	38,787,291	38,787,291	-
( 1 ) 未払手数料	3,386,380	3,386,380	-
( 2 ) その他未払金	3,702,277	3,702,277	-
( 3 ) 未払費用（* 1）	2,764,494	2,764,494	-
負債計	9,853,152	9,853,152	-
デリバティブ取引（* 2）	(87,535)	(87,535)	-

（\* 1）未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

（\* 2）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、（ ）で示しております。

当事業年度（平成25年 3月31日現在）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額

(1) 現金・預金	14,380,327	14,380,327	-
(2) 未収委託者報酬	7,183,011	7,183,011	-
(3) 未収入金	521,825	521,825	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	16,711,401	16,711,401	-
資産計	38,796,567	38,796,567	-
(1) 未払手数料	3,764,501	3,764,501	-
(2) その他未払金	2,908,061	2,908,061	-
(3) 未払費用(*1)	2,782,587	2,782,587	-
負債計	9,455,149	9,455,149	-

(\*1) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

<注1>金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

## 資産

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収入金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(4) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっております。また、投資信託については、基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」をご参照下さい。

## 負債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## デリバティブ取引

注記事項(デリバティブ取引関係)をご参照下さい。

<注2>時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	前事業年度 (平成24年3月31日現在)	当事業年度 (平成25年3月31日現在)
(1) その他有価証券 非上場株式	1,163,689	1,059,169
(2) 子会社株式及び関連会社株式 子会社株式	5,141,069	5,141,069
(3) 差入保証金	542,920	1,000,820

これらは、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるものであるため、時価開示の対象としておりません。

## &lt;注3&gt;金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成24年3月31日現在）

（単位：千円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	3,745,233	-	-	-
未収委託者報酬	6,516,540	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの	836,311	2,069,432	4,320,954	-
合計	11,098,084	2,069,432	4,320,954	-

当事業年度（平成25年3月31日現在）

（単位：千円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	14,380,327	-	-	-
未収委託者報酬	7,183,011	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの	-	1,434,397	4,840,276	-
合計	21,563,339	1,434,397	4,840,276	-

（有価証券関係）

## 1．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成24年3月31日現在）

子会社株式（貸借対照表計上額 5,141,069千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度（平成25年3月31日現在）

子会社株式（貸借対照表計上額 5,141,069千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 2．その他有価証券

前事業年度（平成24年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 （千円）	取得原価 （千円）	差額 （千円）
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの			
その他			



証券投資信託の受益証券	6,864,572	6,497,516	367,056
小計	6,864,572	6,497,516	367,056
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
（１）株式	49,871	55,101	5,230
（２）その他			
証券投資信託の受益証券	21,611,072	21,918,194	307,122
小計	21,660,944	21,973,296	312,352
合計	28,525,516	28,470,813	54,703

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 1,163,689千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

当事業年度（平成25年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 （千円）	取得原価 （千円）	差額 （千円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	93,459	55,101	38,357
（２）その他			
証券投資信託の受益証券	6,224,312	5,440,857	783,455
小計	6,317,771	5,495,959	821,812
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託の受益証券	10,393,629	10,493,953	100,323
小計	10,393,629	10,493,953	100,323
合計	16,711,401	15,989,912	721,489

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 1,059,169千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

### 3．売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

種類	売却額 （千円）	売却益の合計額 （千円）	売却損の合計額 （千円）
その他			
証券投資信託の受益証券	16,215,351	117,695	95,389
合計	16,215,351	117,695	95,389

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

種類	売却額 （千円）	売却益の合計額 （千円）	売却損の合計額 （千円）
（１）株式	141,128	39,827	-
（２）その他			
証券投資信託の受益証券	28,114,625	279,443	36,469

合計	28,255,753	319,271	36,469
----	------------	---------	--------

#### 4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、その他有価証券（その他）について211,376千円の減損処理を行っております。  
 当事業年度において、その他有価証券（非上場株式）について3,220千円の減損処理を行っております。

#### (デリバティブ取引関係)

##### 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引について、取引の対象物の種類ごとの決算日における契約額又は契約において定められた元本相当額、時価及び評価損益並びに当該時価の算定方法は、次のとおりであります。

前事業年度（平成24年3月31日現在）

株式関連

(単位：千円)

区分	デリバティブ取引の種類等	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	株価指数先物取引 売建 TOPIX先物	1,669,315	-	87,535	87,535
	合計	1,669,315	-	87,535	87,535

(注) 時価の算定方法は、東京証券取引所から公表された価格により評価しております。

当事業年度（平成25年3月31日現在）

該当事項はありません。

##### 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

#### (退職給付関係)

##### 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、一時払いの退職金制度、及び確定拠出年金制度を併用しております。

##### 2. 退職給付債務に関する事項

	前事業年度 (平成24年3月31日現在)	当事業年度 (平成25年3月31日現在)
退職給付債務	1,670,344千円	1,935,442千円
退職給付引当金	1,670,344千円	1,935,442千円

## 3. 退職給付費用に関する事項

	前事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	当事業年度 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
勤務費用	261,341千円	301,777千円
その他	160,689千円	167,935千円
退職給付費用	442,030千円	469,713千円

(注) 「その他」は、確定拠出年金への掛金支払額であります。

(税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：千円)

	前事業年度 (平成24年3月31日現在)	当事業年度 (平成25年3月31日現在)
<b>繰延税金資産</b>		
減損損失	838,826	837,121
退職給付引当金	599,247	693,199
賞与引当金	116,690	280,855
連結法人間取引(譲渡損)	258,256	264,269
繰延資産	12	157,330
未払事業税	212,753	154,219
投資有価証券評価損	191,138	128,953
出資金評価損	114,425	114,425
未払社会保険料	14,071	43,411
器具備品	33,365	33,316
役員退職慰労引当金	25,804	24,920
本社移転関連費用引当金	131,676	-
資産除去債務	110,989	-
有価証券評価損	80,344	-
その他有価証券評価差額金	27,099	-
その他	27,474	29,627
繰延税金資産小計	2,782,177	2,761,651
評価性引当額	1,379,241	1,323,069
繰延税金資産合計	1,402,935	1,438,582
<b>繰延税金負債</b>		
連結法人間取引(譲渡益)	2,428,233	2,428,233
建物(資産除去債務)	76,837	-
繰延ヘッジ損益	29,783	-
その他有価証券評価差額金	18,241	257,138
その他	1,888	1,888
繰延税金負債合計	2,554,985	2,687,261
繰延税金負債の純額	1,152,049	1,248,679

## 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の

## 原因となった主要な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

## (資産除去債務関係)

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

## 1. 当該資産除去債務の概要

旧日本の不動産賃貸借契約に係る原状回復義務であります。

## 2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

前事業年度において、移転までの使用見込期間を1年1ヶ月と見積り、過去の不動産賃貸借契約に係る原状回復費用の実績をもとに資産除去債務の金額を計算しております。なお、割引計算による金額の重要性が乏しいことから割引前の見積り額を計上しております。

## 3. 当該資産除去債務の総額の増減

(単位：千円)

変動の内容	前事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	当事業年度 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
期首残高	-	292,000
見積りの変更に伴う増加額	292,000	-
資産除去債務の履行による減少額	-	292,000
期末残高	292,000	-

## 4. 当該資産除去債務の金額の見積りの変更

前事業年度において、本社移転計画に基づく合理的な見積りが可能となったため、当該資産除去債務292,000千円を貸借対照表に計上しております。

## (セグメント情報等)

## [セグメント情報]

当社は、資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

## [関連情報]

## 1. サービスごとの情報

単一のサービス区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 3. 主要な顧客ごとの情報

営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

### [報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

（単位：千円）

	資産運用に関する事業	合計
減損損失	76,217	76,217

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

該当事項はありません。

### [報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

### [報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

## (関連当事者情報)

### 1. 関連当事者との取引

#### (ア) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証(注)	1,372,770	-	-

#### 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) シンガポール通貨庁(MAS)に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行等に関するMASへの損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に

じて保証状にて定められております。

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証(注)	1,591,590	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) シンガポール通貨庁(MAS)に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行等に関するMASへの損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定められております。

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	19,792,278	未払手数料	2,376,978
同一の親会社をもつ会社	大和証券キャピタル・マーケット(株)	東京都千代田区	255,700	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	595,391	未払手数料	76,686
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入	1,233,996	未払費用	245,735

(注) 1. 上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を兄弟会社に支払います。手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定しております。

(2) ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

(3) 大和証券株式会社及び大和証券キャピタル・マーケット株式会社は、平成24年4月1日をもって合併いたしました。

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
----	--------	-----	----------------	-------	-------------------	-----------	-------	----------	----	----------

同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	20,510,864	未払手数料	2,758,584
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入	1,205,721	未払費用	82,519
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料	1,194,567	長期差入保証金	971,157
									未収入金	511,559

(注) 1. 上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (1) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定しております。
- (2) ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。
- (3) 差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

2. 親会社に関する注記

㈱大和証券グループ本社（東京証券取引所、大阪証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(1 株当たり情報)

前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)		当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	
1株当たり純資産額	13,358.92円	1株当たり純資産額	13,506.24円
1株当たり当期純利益	2,692.30円	1株当たり当期純利益	2,694.91円

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

(注) 2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
当期純利益(千円)	7,022,948	7,029,755
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 4 【利害関係人との取引制限】

原簿原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 4 利害関係人との取引制限および5 その他」を次の内容に訂正・更新します。

< 訂正後 >

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）、

運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）、

通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行なうこと。

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。

上記に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

#### 5 【その他】

##### a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

平成24年12月3日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・本店の所在地の変更(東京都千代田区に変更)

##### b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼした事実または重要な影響を及ぼすことが予想される事実

提出日前1年以内において、訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼした事実または重要な影響を及ぼすことが予想される事実はありません。



## 第2 【その他の関係法人の概況】

原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第2 その他の関係法人の概況」を次の内容に訂正・更新します。

< 訂正後 >

### 1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（平成25年3月末日現在）

事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

#### (2) 販売会社

名称 大和証券株式会社

資本金の額 100,000百万円（平成25年3月末日現在）

事業の内容 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

### 2 【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行いません。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

販売会社は、受益権の募集の取扱い、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金・償還金・一部解約金の支払いに関する事務等を行いません。

### 3 【資本関係】

該当ありません。

< 再信託受託会社の概要 >

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成25年3月末日現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的：原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受

託会社へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的と  
します。

## 独立監査人の中間監査報告書

平成25年8月2日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 貞廣 篤典 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ターゲットイヤー2020の平成24年12月19日から平成25年6月18日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCダイワ・ターゲットイヤー2020の平成25年6月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成24年12月19日から平成25年6月18日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法

の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

---

（注1）上記は、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

（注2）中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成25年 5月29日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	森 公 高 印
--------------------	-------	---------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	貞 廣 篤 典 印
--------------------	-------	-----------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	内 田 和 男 印
--------------------	-------	-----------

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第54期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成25年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

---

(注)上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。